

控制系统的哈密顿实现¹⁾

程代展 席在荣

(中国科学院系统科学研究所 北京 100080)

(E-mail: dcheng@isso3.iss.ac.cn)

摘 要 考虑了非线性系统的反馈哈密顿实现问题,主要讨论两类系统:平面系统和输入通道由拉格朗日子空间张成的系统.得到了一些公式和一个一般性的结果,该结果在某些情形下变为更直接可验证条件.

关键词 哈密顿实现,辛流形,拉格朗日子分布.

HAMILTONIAN REALIZATION OF CONTROL SYSTEMS

CHENG Daizhan XI Zairong

(Institute of Systems Science, Chinese Academy of Sciences, Beijing 100080)

Abstract This paper considers the Hamiltonian realization of feedback nonlinear systems. Two kinds of systems are considered: a plane system and a system with input channels spanning a Lagrangian subspace. Certain formulas are obtained. A general result is obtained and it is applied to some special cases to get some directly verifiable conditions.

Key words Hamiltonian realization, symplectic manifold, Lagrangian sub-distribution.

1 基础知识

近年来,辛几何方法被广泛用于哈密顿系统^[1,2],这里首先给出一些相关的结果.

定义1^[3]. M 是一个维数为 $n=2m$ 的流形, ω 是 M 上的一个非退化的、闭的、反对称的 2-形式,则 (M, ω) 称为辛流形, ω 称为辛流形上的辛形式.

在 (M, ω) 上可以定义映射 $\phi: V(M) \rightarrow V^*(M)$ 如下:

$$\phi(X) = \omega(X, \cdot): = \mu \in V^*(M), \quad (1)$$

也记作 $\mu = i_X \omega$ (一般地说, $i_X: \Omega^k(M) \rightarrow \Omega^{k-1}(M)$ 是 k 阶外代数到 $k-1$ 阶外代数的一个同态映射). 由于 ω 非退化, (1) 式定义的映射 ϕ 是 $V(M)$ 和 $V^*(M)$ 之间的一个同构, 这种同

1) 国家自然科学基金(G59837270, G1998020308, G69774008)及国家攀登计划资助项目.

构关系通常用 $X^b = \mu$ 和 $\mu^\# = X$ 表示.

设 $H \in C^\infty(M)$, 则 $dH \in V^*(M)$, 由 H 可以定义一个如下的向量场 $X = (dH)^\#$. 这样的向量场记为 X_H , 称为哈密顿向量场.

定义 2^[1]. 设 (M, ω) 为一个辛流形, 称 (M, ω, H) 为一个哈密顿系统, 其中 $H \in C^\infty(M)$ 为系统的哈密顿函数, 该哈密顿系统的动态方程为 $\dot{x} = X_H$. 达布定理表明存在一个局部坐标卡 $p_1, \dots, p_m, q_1, \dots, q_m$, 使得在该局部坐标卡下, 辛形式可以表示为 $\omega = \sum_{i=1}^m dp_i \wedge dq_i$. 这样的坐标卡称为标准坐标卡.

事实上, 在局部坐标下二阶协变张量场可以由矩阵表示. 设 M_ω 是 ω 的矩阵表示, 即

$$\omega(X, Y) = X^T M_\omega Y, \quad \forall X, Y \in V(M), \quad (2)$$

在标准坐标卡下, 辛形式的矩阵表示为 $M_\omega = \begin{pmatrix} 0 & -I \\ I & 0 \end{pmatrix}$, 哈密顿系统表示为
$$\begin{cases} \dot{q} = \frac{\partial H}{\partial p}, \\ \dot{p} = -\frac{\partial H}{\partial q}. \end{cases}$$

下面考虑哈密顿控制系统. 这里采用文[4]的定义.

定义 3^[4]. 设 (M, ω) 为一个辛流形, 称 $(M, \omega, H_0, H_1, \dots, H_m)$ 为哈密顿控制系统, 其中 $H_i \in C^\infty(M), \forall i$. H_0 称为系统的状态哈密顿函数, 而 $H_i (i=1, \dots, m)$ 称为输出哈密顿函数, 哈密顿控制系统的动态方程为

$$\begin{cases} \dot{x} = X_{H_0} - \sum_{i=1}^m X_{H_i} u_i, \\ y_i = H_i, \quad i = 1, \dots, m. \end{cases} \quad (3)$$

实际上, 哈密顿控制系统有多种定义, 如文[5]. 采用这种定义的理由是基于如下的能量守恒定律

$$\frac{dH_0}{dt} = \sum_{i=1}^m u_i \dot{y}_i,$$

将 y_i 作为广义位移及 u_i 为相应的广义外力, 则上式表明作用在系统上的暂态功等于系统能量的增长率.

2 平面系统

考虑光滑的非线性系统

$$\begin{cases} \dot{x} = f(x) + \sum_{i=1}^m g_i(x) u_i, & x \in R^n, \\ y = h(x); & y \in R^m, \end{cases} \quad (4)$$

其中 $f(0) = 0, g_i(0) (i=1, \dots, m)$ 是线性独立的.

定义 4. 称系统(4)具有反馈哈密顿实现, 如果存在微分同胚 $z = z(x)$ 和状态反馈 $u = \alpha(x) + \beta(x)v$ (其中 $\beta(x)$ 非奇异), 使得反馈系统为哈密顿控制系统. 如果微分同胚和状态反馈是全局的(局部的), 则该实现称为全局的(局部的).

该问题是经典力学中逆问题的推广. 首先考虑平面系统.

定理 1. 设 $n=2$ 及 $m=1$, 系统(4)具有局部反馈哈密顿实现, 当且仅当 $L_g h = 0$.

证明. 因为 $g(0) \neq 0$, 所以存在局部坐标系使得 $g(x) = (1, 0)^T$ ^[6]. 由于 ω 是反对称的, 在该局部坐标下, 可设辛形式 ω 的矩阵表示为

$$M_\omega = \begin{pmatrix} 0 & t(x) \\ -t(x) & 0 \end{pmatrix}. \quad (5)$$

因为二维流形上的任一2-形式都是闭的, 于是当 $t(x) \neq 0$ 时, 由(5)式定义的2-形式是辛形式. 根据(5)式有 $\omega = t(x)dx_1 \wedge dx_2$, 因此, 为得到 $g\beta = X_h$, 当且仅当 $dh = i_{g\beta}(\omega) = t(x)dx_1 \wedge dx_2(g\beta, \cdot) = t(x)\beta(x)dx_2$.

关于充分性, 仅需证明存在 α 使得 $f + g\alpha$ 为一哈密顿向量场. 直接计算得

$$i_{f+g\alpha}\omega = (-tf_2, t(f_1 + \alpha)). \quad (6)$$

根据庞卡莱引理, $f + g\alpha$ 是哈密顿向量场当且仅当(6)式是闭的. 不失一般性, 可以选取 t 为非零常数. 这样(6)式是闭的当且仅当

$$\frac{\partial \alpha}{\partial x_1} = -\frac{\partial f_2}{\partial x_2} - \frac{\partial f_1}{\partial x_1}. \quad (7)$$

显然, 总可以选取适当的反馈 $\alpha(x)$ 满足(7)式.

证毕.

注. 如果状态空间是 R^2 或任意的单连通流形, 庞卡莱引理在全空间上成立. 但是, 在一般情况下表达式 $g = (1, 0)^T$ 仅在局部意义下成立. 从上面的证明过程可以看到, 如果该表达式是全局成立的, 则可得到全局实现.

3 拉格朗日输入分布

定义5. 辛流形 (M, ω) 上的分布 G 称为拉格朗日分布, 如果 G 满足下面的两个等价条件中的一个:

LD1. 在每一点 $x \in M$, $G(x)$ 是辛空间 $(T_x(M), \omega(x))$ 的拉格朗日子空间^[7];

LD2. G 的积分流形是 (M, ω) 的拉格朗日子流形^[1].

由定义可得如下命题.

命题1. 设 (M, ω) 是维数为 $n = 2m$ 的流形. $G(x)$ 为拉格朗日分布, 当且仅当 $\dim(G(x)) = m$ 及

$$\omega(G(x), G(x)) = 0. \quad (8)$$

下面对系统(4)作如下的假设:

A1. $n = 2m$;

A2. 设 $G(x) = \text{span}\{g_1, \dots, g_m\}$ 是拉格朗日分布.

A1和A2的物理意义是很清楚的. 考虑一个由 m 个质点组成的系统, 每个质点受到一个外力作用. 此时, 模型的动力学方程在相平面上就满足A1和A2.

引理1. 如果系统(4)满足A1和A2且具有反馈哈密顿实现, 则 $L_{g_i}h_j = 0, i, j = 1, \dots, m$.

证明. 存在一个局部坐标卡 (V, x) (参看文[3]或[7]), 使得拉格朗日子流形 N 可以表示为 $N \cap V = \{x \in V \mid x_{m+1} = \dots = x_n = 0\}$. 因此, 在局部坐标下, G 可以表示为 $G = \text{span}\{\frac{\partial}{\partial x_i}, i = 1, \dots, m\}$.

记

$$M_\omega = \begin{pmatrix} A(x) & B(x) \\ -B^T(x) & C(x) \end{pmatrix},$$

其中 $A(x)$ 和 $C(x)$ 是反对称的.

利用条件(8)直接计算,得到 $A(x)=0$, 这样 $dh_i = i_{g_i}\omega = (0_{1 \times m} \xi_i)$, $\xi_i \in R^m, i=1, \dots, m$.

证毕.

由引理的证明,只要考虑具有如下矩阵表示的辛形式 ω

$$M_\omega = \begin{pmatrix} 0 & B(x) \\ -B^T(x) & C(x) \end{pmatrix}, \quad (9)$$

其中 $C(x)$ 是反对称的.

以下将看到,为了使得 $f+g\alpha$ 是哈密顿向量场, B 要满足某些条件,而 C 可以任意选取. 因此,考虑这样一个问题:如果 C 可以任意选取,(9)式何时决定一闭形式?

引理2. 给定一个 $m \times m$ 矩阵 $B(x)$, 存在 $C(x)$ 使得(9)式决定一闭形式当且仅当

$$\frac{\partial b_{ij}}{\partial x_k} = 0 (i, j = 1, \dots, m; k \neq i), \quad (10a)$$

$$\frac{\partial}{\partial x_\alpha} \left(\frac{\partial b_{\beta j}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{\beta i}}{\partial x_{m+j}} \right) = \frac{\partial}{\partial x_\beta} \left(\frac{\partial b_{\alpha j}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{\alpha i}}{\partial x_{m+j}} \right) \\ (\alpha, \beta = 1, \dots, m; \alpha \neq \beta; 1 \leq i < j \leq m), \quad (10b)$$

$$\frac{\partial}{\partial x_{m+t}} \left(\frac{\partial b_{kj}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{ki}}{\partial x_{m+j}} \right) = 0 (t, k = 1, \dots, m; 1 \leq i < j \leq m; t \neq i, j). \quad (10c)$$

证明. 由(9)式得到

$$\omega = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^m b_{ij} dx_i \wedge dx_{m+j} + \sum_{1 \leq i < j \leq m} c_{ij} dx_{m+i} \wedge dx_{m+j},$$

因此

$$d\omega = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^m \sum_{k=1, k \neq i}^m \frac{\partial b_{ij}}{\partial x_k} dx_k \wedge dx_i \wedge dx_{m+j} + \\ \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^m \sum_{k=1, k \neq j}^m \frac{\partial b_{ij}}{\partial x_{m+k}} dx_{m+k} \wedge dx_i \wedge dx_{m+j} + \\ \sum_{1 \leq i < j \leq m} \sum_{k=1}^m \frac{\partial c_{ij}}{\partial x_k} dx_k \wedge dx_{m+i} \wedge dx_{m+j} + \\ \sum_{1 \leq i < j \leq m} \sum_{k=1, k \neq i, k \neq j}^m \frac{\partial c_{ij}}{\partial x_{m+k}} dx_{m+k} \wedge dx_{m+i} \wedge dx_{m+j} = 0.$$

对非交叉项得到

$$\frac{\partial b_{ij}}{\partial x_k} = 0 (i, j, k = 1, \dots, m; k \neq i), \frac{\partial c_{ij}}{\partial x_{m+k}} = 0 (1 \leq i < j \leq m; k \neq i, k \neq j). \quad (11)$$

至于交叉项,选取具有 $1 \leq k \leq m$ 和 $1 \leq i < j \leq m$ 的每一项,得到

$$\frac{\partial b_{kj}}{\partial x_{m+i}} dx_{m+i} \wedge dx_k \wedge dx_{m+j} + \frac{\partial b_{ki}}{\partial x_{m+j}} dx_{m+j} \wedge dx_k \wedge dx_{m+i} + \frac{\partial c_{ij}}{\partial x_k} dx_k \wedge dx_{m+i} \wedge dx_{m+j} \\ = \left(-\frac{\partial b_{kj}}{\partial x_{m+i}} + \frac{\partial b_{ki}}{\partial x_{m+j}} + \frac{\partial c_{ij}}{\partial x_k} \right) dx_k \wedge dx_{m+i} \wedge dx_{m+j}.$$

因此得到第三个条件

$$\frac{\partial c_{ij}}{\partial x_k} = \frac{\partial b_{kj}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{ki}}{\partial x_{m+j}} \quad (k = 1, \dots, m; 1 \leq i < j \leq m), \quad (12)$$

(12)式有解 c_{ij} , 当且仅当

$$\frac{\partial}{\partial x_\beta} \left(\frac{\partial b_{\alpha j}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{\alpha i}}{\partial x_{m+j}} \right) = \frac{\partial}{\partial x_\alpha} \left(\frac{\partial b_{\beta j}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{\beta i}}{\partial x_{m+j}} \right) \quad (\alpha, \beta = 1, \dots, m; \alpha \neq \beta; 1 \leq i < j \leq m).$$

如果 \tilde{c}_{ij} 是(12)式的任意一个解, 则

$$\tilde{c}_{ij} = c_{ij} + \phi_{ij}(x_{m+1}, \dots, x_n). \quad (13)$$

下面证明存在 ϕ_{ij} 使 \tilde{c}_{ij} 满足(11)式, 当且仅当(12)式的任意解满足

$$\frac{\partial}{\partial x_k} \left(\frac{\partial c_{ij}}{\partial x_{m+t}} \right) = 0 \quad (k, t = 1, \dots, m; 1 \leq i < j \leq m). \quad (14)$$

必要性由(13)式直接得到. 为证充分性, 就是选取 ϕ_{ij} 使得 $\frac{\partial c_{ij}}{\partial x_{m+t}} + \frac{\partial \phi_{ij}}{\partial x_{m+t}} = 0$.

由上式可知, ϕ_{ij} 的可积性自然满足, 因此 ϕ_{ij} 存在, 而(14)式保证 ϕ_{ij} 不依赖于 $x_i, i=1, \dots, m$. 因此存在 \tilde{c}_{ij} 满足(11).

将(12)代入(14)式得到

$$\frac{\partial}{\partial x_{m+t}} \left(\frac{\partial b_{ij}}{\partial x_{m+i}} - \frac{\partial b_{ki}}{\partial x_{m+j}} \right) = 0 \quad (t, k = 1, \dots, m; 1 \leq i < j \leq m). \quad \text{证毕.}$$

下面考虑这个问题: 给定 $\Lambda = (\lambda_1(x), \dots, \lambda_m(x))$, 何时存在 $Q = (q_1(x), \dots, q_m(x))$ 使得 (Λ, Q) 是闭的?

记 $x^1 = (x_1, \dots, x_m)$ 和 $x^2 = (x_{m+1}, \dots, x_{2m})$, 得到如下引理.

引理3. 给定 $\Lambda = (\lambda_1(x), \dots, \lambda_m(x))$. 存在 $Q = (q_1(x), \dots, q_m(x))$ 使得 (Λ, Q) 是闭的充要条件为

$$\frac{\partial \lambda_i}{\partial x_j^1} = \frac{\partial \lambda_j}{\partial x_i^1}, \quad i, j = 1, \dots, m. \quad (15)$$

证明. 必要性显见. 设(15)式成立, 将 x^2 作为参数, 则由庞卡莱引理, 存在 ϕ , 使 $\frac{\partial \phi}{\partial x_i^1} = \lambda_i, i=1, \dots, m$, 取 $q_j(x) = \frac{\partial \phi(x)}{\partial x_j^2}$ 即可. 证毕.

称坐标 x 对 G 是友好的, 如果 $G = \text{span} \left\{ \frac{\partial}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial}{\partial x_m} \right\}$.

总括上面的讨论得到如下定理.

定理2. 假设系统(4)满足 A1 和 A2, 则系统(4)具有局部哈密顿实现当且仅当

1) $L_{g_i} h_j = 0, i, j = 1, \dots, m$;

2) 存在非奇异矩阵 $B(x)$ 满足(10)式. 且 $\Lambda = (f^2)^T B^T$ 满足(15)式. 这里 $f = ((f^1)^T, (f^2)^T)$, x 是对 G 友好的坐标卡.

证明. 由引理得到1). 已知 $\text{span} \{ (dh_1)^\#, \dots, (dh_m)^\# \} = G$, 因此存在 β 使得

$$(g_1, \dots, g_m)\beta = (X_{h_1}, \dots, X_{h_m}).$$

关于2), 有

$$(f + g\alpha)^b = ((f^1 + I_m \alpha)^T, (f^2)^T) \begin{pmatrix} 0 & B(x) \\ -B^T(x) & C(x) \end{pmatrix} = (-f^2)^T B^T Q),$$

既然 α 和 Q 是任意的,由引理2和3可以得到2).

证毕.

4 某些特殊情形的应用

本节讨论一些特殊系统,使得定理2的条件具体化.

推论1. 假设系统(4)满足(i)A1和A2;(ii)存在非奇异矩阵 B 满足(10)式;(iii) $[f, G] \subset G$,则(4)式有反馈哈密顿实现.

证明. 与定理2的条件比较,仅需证明如下两件事

首先要证明 $(f^2)^T B^T$ 满足(15)式. 因为 $G = \text{span}\{(I_m \ 0)^T\}$,易验证条件(iii)隐含着 f^2 与 x^1 无关. 由(10)式也可知 $b_{ji} = b_{ji}(x_j^1, x^2)$, $i, j = 1, \dots, m$, 则 $(f^2)^T B^T = (\sum_{i=1}^m f_i^2(x^2) b_{1i}(x_1^1, x^2), \dots, \sum_{i=1}^m f_i^2(x^2) b_{mi}(x_m^1, x^2))$, 从而(15)式显然满足. 证毕.

设 G 是非奇异对合分布, $x = (x^1, x^2)$, 且 $G = \text{span}\{\frac{\partial}{\partial x^1}\}$. $f = \text{col}(f^1, f^2)$ 是在局部坐标 x 下表示的向量场. $z = z(x)$ 是 G 的另一个友好坐标. 我们考查 f 在 G 的两个友好坐标之间的坐标变换下的表达式.

记 z 的雅可比矩阵为

$$J_z = \begin{pmatrix} \frac{\partial z^1}{\partial x^1} & \frac{\partial z^1}{\partial x^2} \\ \frac{\partial z^2}{\partial x^1} & \frac{\partial z^2}{\partial x^2} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} J_{11} & J_{12} \\ J_{21} & J_{22} \end{pmatrix},$$

不难看出 z 对 G 是友好的,则 $J_{21} = 0$. 因此

$$J_z = \begin{pmatrix} J_{11} & J_{12} \\ 0 & J_{22} \end{pmatrix},$$

而且 J_{22} 与 z^1 无关. 在 z 坐标下 f 为

$$f^2(z) = J_{22}(z^2) f^2(x^1(z), x^2(z^2)). \quad (16)$$

推论2. 设满足 A1和A2,且(a) $L_{g_i} h_j = 0 (i, j = 1, \dots, m)$; (b) $\frac{\partial f^2}{\partial x^1}$ 非奇异. 则方程(4)有反馈哈密顿实现.

证明. 首先要证明条件(b)与坐标的选取无关. 由(16)式可知

$$\frac{\partial f^2}{\partial z^1} = J_{22} \frac{\partial f^2}{\partial x^1} \frac{\partial x^1}{\partial z^1},$$

它非奇异当且仅当 $\frac{\partial f^2}{\partial x^1}$ 非奇异.

选取坐标

$$z^1 = f^2(x), \quad z^2 = x^2.$$

显然该坐标对 G 是友好的. 随后选取 $B = -I_m$ 和 $Q = 0$, 则易验证定理2的条件满足.

证毕.

注. 事实上,推理2中反馈系统的状态哈密顿函数是

$$H_0 = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^m (x_i^1)^2,$$

这正是系统的动能.

例. 考虑线性系统

$$\dot{x} = Ax + Bu, \quad x \in R^n, \quad y \in R^m \quad (17a)$$

$$y = Cx, \quad n = 2m. \quad (17b)$$

设 x 对 B 友好, 则不妨设 $B = (I, 0)^T$, 由 $L_{g_i} h_j = 0$ 得

$$C = (0, I). \quad (18)$$

记 $A = \begin{bmatrix} A_{11} & A_{12} \\ A_{21} & A_{22} \end{bmatrix}$, 设 $B(x) = P_0 + P_1(x)$, 这里 $P_1(x) = O(\|x\|)$. 则易证, 如果 $(f^2)^T B^T(x)$ 满足 (15) 式, $(f^2)^T P_0^T$ 也满足 (15) 式. 因此不失一般性, 可选 (9) 式中 $B(x) = P = \text{const}$. 则 (10) 式显然成立. 令 $(f^2)^T P^T = [(x^1)^T A_{21}^T + (x^2)^T A_{22}^T] P^T$ 满足 (15) 式. 容易证明它等价于 $A_{21}^T P^T$ 为对称阵, 即

$$P A_{21} = A_{21}^T P^T, \quad (19)$$

故线性系统 (17) 式有哈密顿实现, 当且仅当 (18) 式成立, 且存在非奇异 P , 使 (19) 式成立. 证毕.

5 结论

控制系统的反馈哈密顿实现是力学中哈密顿系统的逆向题的推广^[4]. 本文考虑了两种特殊情形: 1) 平面系统; 2) 输入分布为拉格朗日子分布. 得到了几个有用的判据.

由于哈密顿系统在系统镇定、 H_∞ 控制设计等方面有许多方便之处^[5], 哈密顿实现为非线性控制系统的设计提供了一条新的途径.

参 考 文 献

- 1 Abraham R A, Marsden J E. Foundations of Mechanics, 2nd Ed. Benjamin/Cummings Pub. Com. Inc., 1978
- 2 Arnold V I. Mathematical Methods of Classical Mechanics, New York; Springer, 1978
- 3 Libermann P C Marle. Symplectic Geometry and Analytical Mechanics, Translated by B. E. Schwarzbach, D. Reidel Pub. Comp. 1987
- 4 Crouch P E, van der Schaft A J. Variational and Hamiltonian Control Systems, Lecture Notes in Control and Information Sciences 101, Springer-Verlag, 1987
- 5 van der Schaft A J. L_2 -Gain and Passivity Techniques in Nonlinear Control, Springer-Verlag, 1996
- 6 Spivak M. Differential Geometry, Publish or Perish Inc., 1979
- 7 Koszul J *et al.* 辛几何, 北京: 科学出版社, 1997
- 8 李继彬, 赵晓华, 刘正荣. 广义哈密顿系统理论及其应用, 北京: 科学出版社, 1997

程代展 1946年生, 1970年于清华大学, 1985年于 Washington University 获博士学位. 1990年到1993年为国际杂志 J. Math. Systems, Estimation and Control 及 Automation 副主编, 现为中科院系统所研究员, 博士生导师. 主要研究兴趣为非线性控制与数值方法.

席在荣 1969年生, 1988年毕业于湖南常德师范学校, 1997年于郑州大学获硕士学位. 现为中科院系统所博士生. 主要研究兴趣为非线性控制.